

Daftar Isi

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERSETUJUAN	iii
HALAMAN PERNYATAAN	iv
KATA PENGANTAR.....	v
HALAMAN PERSEMBAHAN.....	vi
Daftar Tabel	ix
Daftar Gambar	x
Daftar Lampiran.....	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACTS	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Perumusan Masalah	4
1.3 Tujuan Penelitian	4
1.4 Manfaat Penelitian	5
1.5 Sistematika Penulisan	5
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	8
2.1 Pasar Modal (<i>Capital Market</i>).....	8
2.2 Efisiensi Pasar (<i>Market Efficiency</i>)	8
2.3 Return Taknormal (<i>Abnormal Return</i>).....	11
2.4 Saham LQ-45	11
2.5 <i>Event Study</i>	13
2.6 Penelitian Terdahulu dan Pengembangan Hipotesis.....	15
BAB III METODA PENELITIAN.....	19
3.1 Populasi dan Sampel.....	19

3.2	Jenis dan Sumber Data.....	19
3.3	Penentuan Periode Penelitian	20
3.4	Metoda Analisis Data dan Pengujian Hipotesis	22
3.4.1	Pengujian Hipotesis 1	22
3.4.2	Pengujian Hipotesis 2	26
BAB IV ANALISIS DAN PEMBAHASAN		28
4.1	Data.....	28
4.2	Statistik Deskriptif	29
4.3	Uji Normalitas Data	29
4.4	Hasil Pengujian Hipotesis 1	30
4.5	Hasil Pengujian Hipotesis 2	34
BAB V PENUTUP		38
5.1	Kesimpulan.....	38
5.2	Keterbatasan	39
5.3	Saran	39
Daftar Pustaka		40